**ECONOMETRÍA AVANZADA: CORTE TRANSVERSAL Y PANEL**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Clave** | : | ECO780 | **Créditos** | : | 3 |
| **Tipo** | : | Obligatorio | **Semestre** | : | 2017-2 |
| **Horario** | : | ------ | **Aula clase****Práctica Dirigida**  | :: | ---------- |
| **Profesor****Jefe de Practica** | :: | **M01: Jose Galdo** **-----** | **Requisito** | : | Econometría Intermedia |

1. **Sumilla**

Estrategias empíricas de estimación de modelos causales, contrafactuales, sesgo de selección, selección en observables. Método experimental. Métodos no experimentales. Métodos de diferencias en diferencias. Método de Apareamiento. Regresiones discontinuas. Funciones de control. Estimación semi-paramétrica y no paramétrica. Aplicaciones.

1. **Objetivos de aprendizaje**

El objetivo del módulo es presentar modelos econométricos que se utilizan en la identificación y estimación de efectos causales. Se abarcan aproximaciones experimentales como no-experimentales en sus dimensiones tanto teóricas como prácticas. Se pondrá énfasis en la discusión de los supuestos de identificación, implementación de los diversos modelos, e interpretación de los parámetros estimados. Aplicaciones que utilizan data e intervenciones en el Perú recibirán atención.

1. **Contenido**

El problema de causalidad en las ciencias sociales

Métodos experimentales

Métodos no-experimentales

El modelo de diferencias en diferencias

El método de apareamiento

El método de regresión discontinua

Aplicaciones

1. **Metodología**

Lo módulos se dictarán en sesiones teóricas en Power Point y sesiones de práctica, las cuales consisten en la revisión de ejercicios, discusión de casos, sesiones de lectura y/o prácticas en laboratorio. Habrá un trabajo práctico que fortalecerá los conocimientos.

1. **Sistema de evaluación**

Ejercicios Calificados 35%

Examen Final 65%

1. **Bibliografía:**

**6.1 The fundamental identification problem: Endogeneity. Selection Bias. Causality. Counterfactual Responses.**

* (\*) Lecture Notes
* Rubin, Donald B. (1974). “Estimating causal effects of treatments in randomized and nonrandomized experiments”, Journal of Educational Psychology 66, pp.688-701.
* Holland, Paul W. (1985). “Statistics and causal inference.” Journal of the American Statistical Association. Vol.81, N° 396, Theory and Methods.
* Moffitt, Robert. 2005. “Remarks on the Analysis of Causal Relationships in Population Research.” *Demography* 42(1): 91-108.
	1. **Randomized Evaluation Designs**
* (\*) Lecture Notes
* (\*) Burtless, Gary. 1995. “The Case for Randomized Field Trials in Economic and

 Policy Research.” *Journal of Economic Perspectives*. 9(2): 63-84.

* Heckman, James J., and Jeffrey A. Smith (1995) “Assessing the Case for Social

 Experiments”, *Journal of Economic Perspectives*, 9(2): 85-110.

* Duflo, Esther, Glennerster, Rachel and Kremer, Michael (2006). “Using Randomization in Development Economics Research: A Toolkit”. MIT Department of Economics Working Paper No. 06-36.
* (\*) Dammert, A, J. Galdo, and V. Galdo. “Preventing Dengue through Mobile Phones: Evidence from a Field Experiment in Peru” .2014. *Journal of Health Economics,* 35: 147-161.
* (\*) DA Black, JA Smith, MC Berger, BJ Noel . 2004. “[Is the threat of reemployment services more effective than the services themselves? Evidence from random assignment in the UI system](http://scholar.google.com/citations?view_op=view_citation&hl=en&user=f5cYgO0AAAAJ&citation_for_view=f5cYgO0AAAAJ:UeHWp8X0CEIC)”, *The American Economic Review*, 93 (4), 1313-1327
* Banerjee, Abhijit V., Shawn Cole, Esther Duflo, Leigh Linden (2007). "Remedying Education: Evidence from Two Randomized Experiments in India" *Quarterly Journal of Economics* 122:3, 1235-1264

**6.3 El Estimador de Diferencias en Diferencias**

* (\*) Lecture Notes
* (\*) Card, D. and A. B. Krueger (1994), Minimum Wages and Employment: A Case Study of the Fast-Food Industry in New Jersey and Pennsylvania, *The American Economic Review*, Vol. 84.
* (\*) Galiani, Sebastian, Paul Gertler and Ernesto Schargrodsky. (2005). “Water for life: the impact of the privatization of water services on child mortality.” The Journal of Political Economy, Vol. 113, No. 1 (Feb.).
* (\*) Galdo, J. “Long-Run Labor-Market Impacts of Early-Life Exposure to Civil War: Evidence from Shining Path in Peru,” 2013. *Economic Development and Cultural Change,* 61(4):789-923*.*

**6.4 El Método de Matching**

* (\*) Lecture Notes
* Heckman, James J., Hidehiko Ichimura y Petra E. Todd. (1997). “Matching as an econometric evaluation estimator: evidence from evaluating a job training programme.” The Review of Economic Studies, Vol. 64, No. 4, Special Issue: Evaluation of Training and Other Social Programmes (Octubre).
* (\*) Rosenbaum P.R. y Donald B. Rubin. (1983). “The central role of the propensity score in observational studies for causal effects.” Biometrika, Vol. 70 No 1.
* (\*) Lalonde, Robert J. (1986). Evaluating the econometric evaluations of training programs with experimental data. The American Economic Review, Vol. 76, No. 4 (Sep).
* (\*) Dehejia, R. and S. Wahba. 2002. “Propensity Score Matching Methods for

Nonexperimental Causal Studies,” *Review of Economics and Statistics* 84(1).

* (\*) Smith J., and P. Todd 2005a. “Does Matching Overcome Lalonde’s Critique of Non-Experimental Estimators?,” *Journal of Econometrics,* 125(1-2).
* Dehejia, R. 2005. “Practical propensity score matching: a reply to Smith and Todd” *Journal of Econometrics* 125 (1-2).
* Smith, J. and P. Todd. 2005b. “Rejoinder,” *Journal of Econometrics* 125 (1-2).
* (\*) Galdo, J. and A. Chong. “Does the Quality of Public-Sponsored Training Programs Matter? Evidence from Bidding Processes Data.” 2012. *Labour Economics,* 19(6): 970-986.

**6.5 El Diseño de Regresión Discontinua**

* (\*) Lecture Notes
* (\*) Hahn, Todd y Van der Klaauw. (2001). “Identification and Estimation of treatment effects with a regression-discontinuity design”, Econometrica, Vol. 69, No 1 (January).
* Imbens, Guido y Thomas Lemieux. (2007). “Regression discontinuity designs: a guide to practice”. National Bureau of Economic Research, Working Paper N° 13039,
* (\*) Dell, Melissa. “The Persistent Effect of Peru’s Mining Mita,” 2010. *Econometrica* 78(6): 1863-1903
* (\*) Thomas Lemieux and Kevin Milligan. 2008. “Incentive effects of social assistance: A regression discontinuity approach” *Journal of Econometrics* 142(2).
* (\*) Black D., J. Galdo, and J. Smith. “Evaluating the Worker Profiling and Reemployment Services System Using a Regression Discontinuity Approach.” 2007. *American Economic Review*, 97(2):104-107.

(\*) Lecturas Obligatorias